

**GOLDMAN SACHS G 1.375% 05/24 / XS1614198262**
**Grado di rischio calcolato**

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

**Grado Liquidità**

Molto liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,83 EUR	Goldman Sachs Group	15/05/2024	1,375%	1,209%	0,854%


**Analisi**

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	100,83
Rendimento lordo	1,20917
Rendimento netto	0,85374
Cedola in corso	1,37500
Rateo lordo	1,03596
Rateo netto	0,76661
Vita residua	5,25205
Duration modificata	4,99289
Convessità	30,53933
Cedola successiva	1,37500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/05/2017
Prezzo emissione	99,9930
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2017
Tasso annuale	1,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2024
Data estinzione	15/05/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

**Mercati di quotazione**

Mercato	Data	Valore	Valuta
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	101,0400	EUR
Frankfurter Börse	12/02/2019	100,8300	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	100,7500	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	100,8700	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	100,7500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	101,1800	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,9320	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,7900	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,1500	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	0	365
15/05/2020	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	0	366
15/05/2021	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	0	365
15/05/2022	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	0	365
15/05/2023	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	0	365
15/05/2024	1,375	1,375	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	366

**Call**

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
---	15/05/2023	15/05/2023	100	30